



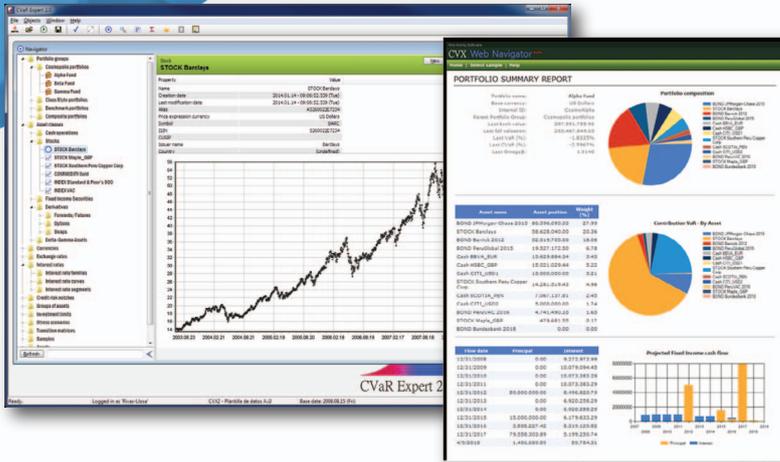
CVX ▶

Análisis de Riesgo para Carteras Institucionales

Fondos de inversión | Aseguradoras | Bancos privados | Family Offices | Reguladores

► Cumplimiento regulatorio y análisis de inversiones

Los inversores institucionales asumen cotidianamente el doble reto de cumplir con los requerimientos regulatorios de Basilea y, además, disponer de indicadores de alto valor estratégico para la toma de decisiones de inversión y gestión de riesgos. **CVX** hace posible atender este desafío con un admirable nivel de automatización, transparencia y solidez metodológica.



CVX permite aplicar automáticamente una amplia gama de modelos y herramientas, tales como:

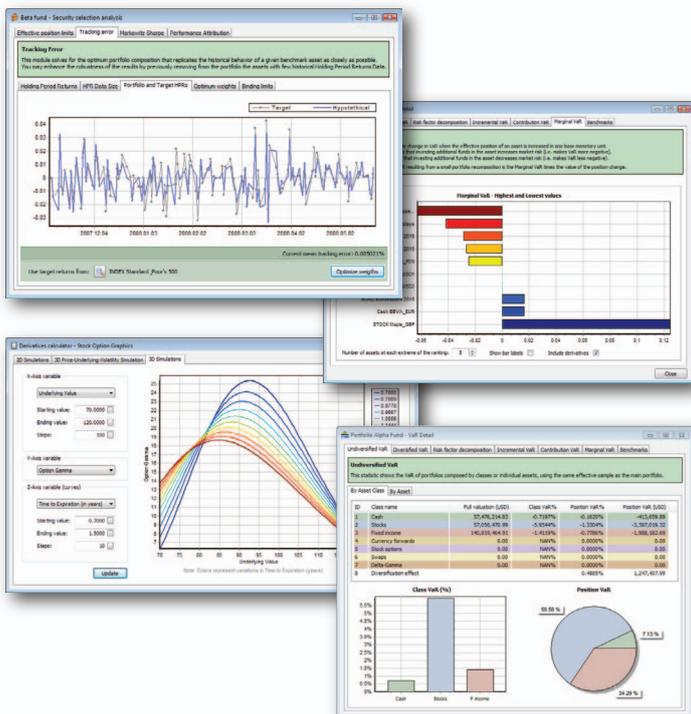
- Valoración completa de carteras
- Valor-en-Riesgo y VaR Condicional no paramétrico
- Control de límites de inversión
- Análisis de coberturas con derivados
- Descomposición Marginal e Incremental de riesgo
- Análisis de atribución de desempeño
- Análisis de estrés y simulación *what-if*
- Análisis de matrices de transición crediticia
- Generación automática de reportes

► Respuesta en tiempo real

Gracias a un sofisticado diseño, **CVX** es capaz de aplicar modelos de valoración, simulación y comprobación a una sorprendente velocidad, incluso tratándose de carteras complejas, compuestas de numerosos activos y factores de riesgo. Esto hace posible que el usuario simule fácilmente nuevas posiciones, estructuras, coberturas o factores de riesgo y disponga de acceso inmediato a los resultados. Adicionalmente, todos los cálculos centrales dejan una traza detallada que puede emplearse con fines de auditoría, verificación o como insumo para otros análisis.

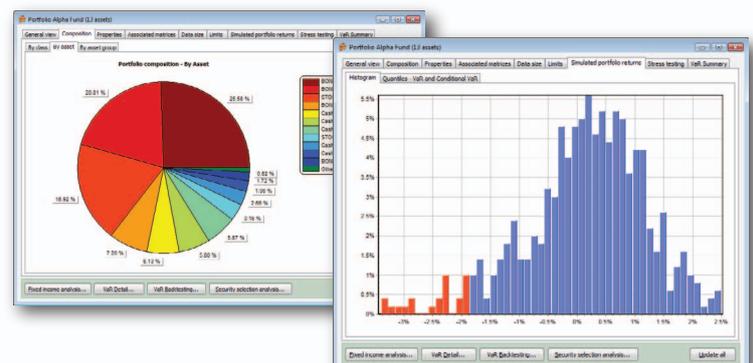
“Cuanto más empleamos el sistema CVX más nos preguntamos ¿y cómo lo hacíamos antes?”

BBVA Global Wealth, Zürich



► Experiencia visual

La complejidad de los modelos de medición y gestión de riesgo no debe impedir a los analistas acceder rápidamente a los elementos clave para la toma de decisiones. **CVX** dispone de gráficos, reportes y reseñas técnicas cuidadosamente configuradas. La interfaz del programa ha sido diseñada directamente por expertos en análisis de inversiones y riesgos siguiendo criterios de máxima claridad y productividad.

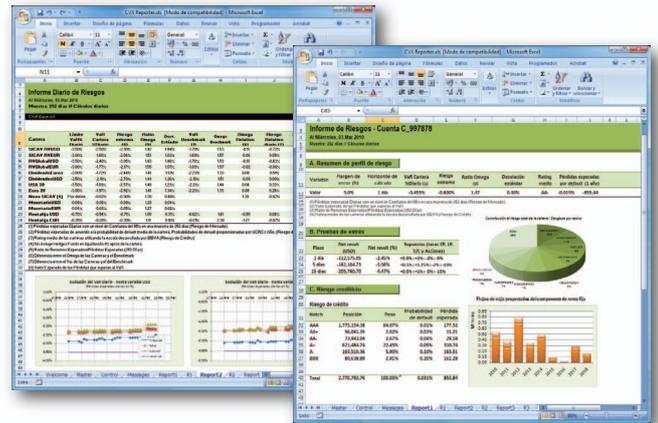


▶ Seguro y plenamente interconectable

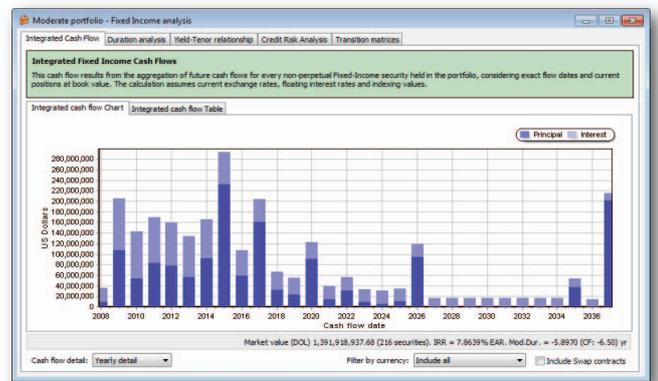
CVX opera bajo una arquitectura de tipo *sand-box*, donde cada usuario dispone de un espacio de trabajo independiente para el análisis. Los datos base de mercado, activos, carteras y demás insumos pueden tomarse de un repositorio central; pero los cálculos y variaciones que cada usuario realice en su propio ordenador no pueden afectar ningún dato transaccional.

La información base para alimentar el sistema incluye desde aspectos sencillos como precios, estructuras, flujos, curvas de tasas y posiciones, hasta elementos más complejos como estrategias dinámicas de cobertura, probabilidades de transición crediticia, calces de activos y pasivos o incidencia tributaria y de comisiones sobre el desempeño.

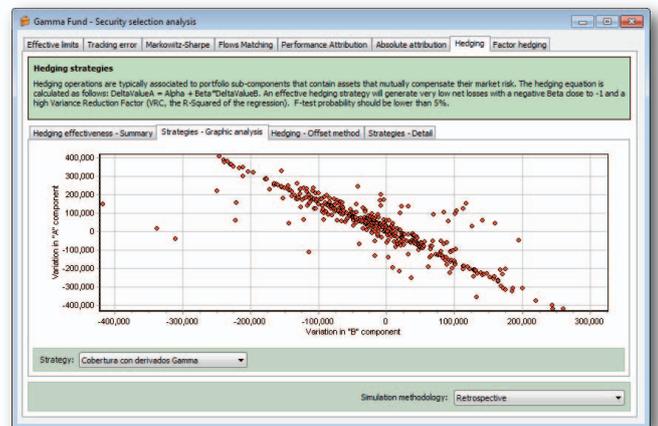
CVX puede interconectarse con la plataforma Bloomberg® para capturar automáticamente información de mercado, y con cualquier base de datos transaccional o incluso archivos de MS Excel® o MS Access® para cargar en línea los aspectos propios de la operación del inversionista.



Reportes automáticamente generados en MS Excel®



Proyección de flujos de caja futuros de una cartera compleja



Análisis de eficacia de cobertura de una estrategia con derivados



▶ Acompañamiento técnico y metodológico

La puesta en marcha de la plataforma **CVX** incluye capacitación presencial especializada para todos los analistas clave. El contenido cubre desde los aspectos académicos de los modelos aplicados por el sistema hasta el uso de la aplicación misma con datos reales del cliente.

Tras la puesta en operaciones de la solución, el equipo profesional de **RISKO** brinda a sus clientes soporte y acompañamiento que llega mucho más allá de los aspectos informáticos. Nuestros expertos brindan apoyo permanente en materia de modelos de análisis, interpretación de indicadores de riesgo e identificación de mejores prácticas, entre otras materias.

Solicite una demostración del sistema hoy mismo contactándose con nosotros a mail@risk-o.com o al +1.800.573.RISK.



Algunos usuarios del sistema

CVX



www.risk-o.com | mail@risk-o.com | +1.800.573.7475

